

**Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»
(Финансовый университет)**

**Департамент финансовых рынков и финансового инжиниринга
Финансового факультета**

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной и
методической работе

_____ Е.А. Каменева

«28» марта 2023 г.

Куликова Е.И.

ПРОГРАММА ПРОИЗВОДСТВЕННОЙ ПРАКТИКИ

для студентов, обучающихся по направлению подготовки
38.04.08 «Финансы и кредит»,
направленность программы магистратуры
«Финансовая математика и анализ рынков»

*Рекомендовано Ученым советом Финансового факультета
(протокол № 32 от 21 марта 2023 г.)*

*Одобрено Советом учебно-научного
Департамента финансовых рынков и банков
(протокол № 11 от 21 декабря 2022 г.)*

Москва 2023

Содержание

1. Наименование вида и типов практики, способа и формы (форм) ее проведения	3
2. Цели и задачи практики.....	3
3. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения при прохождении практики	4
4. Место практики в структуре образовательной программы	7
5. Объем практики в зачетных единицах и ее продолжительность в неделях либо в академических часах	7
6. Содержание практики	8
7. Формы отчетности по практике.....	10
8. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по практике.....	13
9. Перечень учебной литературы и ресурсов сети «Интернет», необходимых для проведения практики:	17
10. Перечень информационных технологий, используемых при проведении практики, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем	19
11. Описание материально-технической базы, необходимой для проведения практики.	21
Приложения	22

1. Наименование вида и типов практики, способа и формы (форм) ее проведения

Наименование вида практики: производственная

Тип практики: практика по профилю профессиональной деятельности; преддипломная практика.

Форма проведения практики: непрерывно

Способы проведения практики: стационарная

2. Цели и задачи практики

Целью производственной практики является применение новых знаний, приобретенных в процессе обучения в профессиональной деятельности; получение опыта практической реализации профессиональных компетенций и умений; получение результатов научных исследований по программе магистерской подготовки

Задачами производственной практики являются:

- овладение профессиональными навыками работы и решение практических задач;
- сбор и обобщение материала для подготовки магистерской диссертации;
- использование современных методов и средств анализа финансовых рынков при решении прикладных задач;
- приобретение навыков работы с современными программными и аппаратными средствами информационных технологий, используемыми для анализа финансовых рынков.
- приобретение практического опыта работы в коллективе.

3. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения при прохождении практики

Таблица 1

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с индикаторами достижения компетенции
компетенции направленности программы магистратуры ДКН для 2021г./ Профессиональные компетенции ПК для 2022г и т.д.			
ДКН-1/ ПК-1	Способность осуществлять разработку теоретических и новых экономических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной деятельности в области финансов и кредита, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты, выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками	<p>1. Использует весь спектр моделей и методов моделирования для отображения и выявления причинно-следственных связей во всем спектре экономических и финансовых объектов и рисков макро- и микроуровней.</p> <p>2. Демонстрирует возможности верификации результатов моделирования, содержательной и достоверной интерпретации причинно-следственных связей, прогнозирования изменений на макро- и микроуровнях.</p> <p>3. Использует системный анализ для поиска и структуризации решений по преодолению проблем и урегулированию рисков экономических и финансовых объектов.</p>	<p>1. Знание: основных теорий и методологий исследования процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной деятельности в области финансов и кредита;</p> <p>Умение: использовать современные информационные системы для проведения анализа товарных рынков как базиса финансовых рынков.</p> <p>2. Знание: методов оценки финансово-экономических рисков макроэкономического и отраслевого уровня, оказывающих влияние на деятельность хозяйствующих субъектов, являющихся участниками финансового рынка, и интерпретация полученных результатов</p> <p>Умение: выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков макроэкономического и отраслевого уровня, оказывающих влияние на деятельность хозяйствующих субъектов, являющихся участниками финансового рынка.</p> <p>3. Знание: методологии разработки эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере</p>

			<p>профессиональной деятельности в области финансов и кредита;</p> <p>Умение: разрабатывать обоснованные эконометрические модели отдельных финансовых операций, направленных на защиту от рисков, либо извлечение прибыли организации; строить прогнозы динамики цен на различные финансовые активы</p>
ДКН-3 / ПК-3	Способность применять современные теории, в том числе теорию стохастических процессов для анализа и прогнозирования финансовых рынков	<p>1. Владеет методами стохастики для изучения, интерпретации, объяснения и прогнозирования процессов макро- и микроуровней на финансовых рынках.</p> <p>2. Широко использует программный инструментарий, базы данных и современные методы их обработки для построения и интерпретации моделей стохастических процессов на финансовых рынках.</p>	<p>1. Знание: современных теорий, в том числе теорию стохастических процессов для анализа и прогнозирования финансовых рынков</p> <p>Умение: применять современные теории, в том числе теорию стохастических процессов для анализа и прогнозирования финансовых рынков</p> <p>2. Знание: методов и инструментов обработки данных</p> <p>Умения: использовать широкий инструментарий обработки данных для построения и интерпретации моделей стохастических процессов на финансовых рынках.</p>
ДКН-4/ ПК-4	Способность управлять инвестиционным портфелем индивидуальных и институциональных инвесторов на основе фундаментального и технического анализа, оценки финансовых инструментов, оценки финансовых рисков и управления	<p>1. Использует методический инструментарий оценки эффективности управления портфелем финансовых активов, деятельности профессиональных участников финансового рынка.</p> <p>2. Использует методы оценки финансовых рисков для выработки рекомендаций по их эффективному хеджированию.</p>	<p>1. Знание: методов фундаментального и технического анализа, используемых при оценке стоимости финансовых инструментов;</p> <p>Умение: использовать принципы разработки торговых стратегий на рынке финансовых инструментов.</p> <p>2. Знание: методов оценки финансовых рисков для выработки рекомендаций по их эффективному хеджированию</p> <p>Умение: Использовать методы оценки финансовых рисков для выработки рекомендаций по их эффективному хеджированию.</p>

	рисками инвестиционного портфеля		
ПКН - 3	Способность проводить анализ, обобщать и критически оценивать полученные результаты исследования для разработки финансовых аспектов перспективных направлений инновационного развития, минимизации рисков, достижения финансовой устойчивости организаций (включая финансово-кредитные организации), долгосрочной устойчивости бюджетной системы, составления финансовых обзоров, экспертно-аналитических заключений, отчетов и научных публикаций в области финансов и кредита	<p>1. Владеет методами прикладных научных исследований в профессиональной сфере.</p> <p>2. Применяет современные методы анализа и оценки рисков деятельности организаций (включая финансово-кредитные организации), бюджетных рисков и предлагает решения по их минимизации в контексте достижения финансовой стабильности и долгосрочной устойчивости.</p> <p>3. Разрабатывает направления инновационного развития как организаций (включая финансово-кредитные организации), отдельных продуктов и услуг, так и публично-правовых образований.</p> <p>4. Оформляет результаты анализа и оценки в форме финансовых обзоров, экспертно-аналитических заключений,</p>	<p>1. Знание: методы комплексного экономического и финансового анализа для оценки результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления</p> <p>Умение: анализировать результаты и эффективность хозяйственной деятельности финансово-кредитных организаций</p> <p>2. Знание: современных методов анализа и оценки рисков деятельности организаций (включая финансово-кредитные организации), бюджетных рисков</p> <p>Умение: разрабатывать решения по минимизации рисков деятельности финансово-кредитных организаций в контексте достижения ими финансовой стабильности и долгосрочной устойчивости.</p> <p>3. Знание: принципов составления финансовых обзоров, экспертно-аналитических заключений, отчетов и научных публикаций</p> <p>Умение: составлять финансовые обзоры, экспертно-аналитические заключения, отчеты и научные публикации</p> <p>4. Знание: порядка оформления результатов научных исследований в виде обзоров, заключений, отчетов, публикаций</p> <p>Умение: готовить и обосновывать результаты анализа и оценки деятельности</p>

			страховой организации в виде отчетов и научных публикаций
УК - 5	Способность руководить работой команды, принимать организационно управленческие решения для достижения поставленной цели, нести за них ответственность	1.Организовывает работу в команде, ставит цели командной работы. 2.Вырабатывает командную стратегию для достижения поставленной цели на основе задач и методов их решения. 3.Принимает ответственность за принятые организационно-управленческие решения.	1.Знание: основных приемов и методов организации работы в команде, включая постановку целей командной работы, Умение использовать основные приемы и методы организации работы в команде, включая постановку целей командной работы, на практике. 2.Знание: основных приемов и методов разработки командной стратегии для достижения поставленной цели, Умение: использовать основные приемы и методы разработки командной стратегии для достижения поставленной цели, на практике. 3.Знание: возможных последствий, принятых организационно--управленческих решений, возникающую меру ответственности. Умение: оценивать последствия принятых организационно управленческих решений, возникающую меру ответственности на практике.

4. Место практики в структуре образовательной программы

Производственная практика обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», направленность программы магистратуры, «Финансовая математика и анализ рынков» относится к Блоку 2. Практика, в том числе научно-исследовательская работа (НИР) и является обязательным разделом образовательной программы магистратуры.

5. Объем практики в зачетных единицах и ее продолжительность в неделях либо в академических часах

Производственная практика проводится в сроки, определённые календарным учебным графиком обучающихся по направлению подготовки

38.04.08 «Финансы и кредит», направленность программы магистратуры «Финансовая математика и анализ рынков» - 15 зачетных единиц.

Типы производственной практики: практика по профилю профессиональной деятельности - 12 зачетных единиц; преддипломная практика - 3 зачетные единицы

Продолжительность производственной практики - 10 недель.

Вид промежуточной аттестации - зачет с оценкой в 7 модуле (2 курс), проводимый в форме защиты отчета по производственной практике.

6. Содержание практики

Таблица 2

Типы профессиональных задач	Виды работ (в форме контактной работы, в форме самостоятельной работы)	Количество рабочих дней
1. Изучение применяемых в организации методов и моделей исследования результатов деятельности	1. Изучение применяемых методов и методик расчета основных показателей, характеризующих деятельность финансовой организации (ДКН-1/ПК-1, ДКН-4/ПК-4) 2. Изучение основных инноваций (финансовые продукты, направления инвестиций и др.), применяемых в финансовых организациях (ДКН-1/ПК-1, ПКН-3) 3. Изучение применяемых технологий взаимосвязи и взаимодействия структурных подразделений, их соответствие целям и задачам деятельности организации на финансовых рынках (ДКН-4/ПК-4, ПКН-3, УК-5); 4. Сопоставление динамики экономических показателей деятельности структурных подразделений организации, отвечающих за реализацию различных бизнес-процессов, характеристика их эффективности (ПКН-3, УК-5).	10
2. Характеристика основной (дилерской, брокерской, по доверительному управлению и др.) и инвестиционной деятельности на финансовых рынках организации – базы производственной практики 2.1 Показатели основной деятельности организации – базы производственной практики, их динамика и анализ 2.2 Показатели	1. Изучить и проанализировать показатели, характеризующие основную деятельность организации за предшествующие два года, выявить их динамику (ПКН-3, ДКН-1/ПК-1, ДКН-4/ПК-4); 2. Сопоставить динамику основных показателей деятельности организации средними показателями по рынку, выявить расхождения, объяснить их причины, предложить пути преодоления негативных тенденций (ПКН-3, ДКН-1/ПК-1, ДКН-3/ПК-3); 3. Провести анализ финансового состояния организации, разработать и обосновать предложения по его укреплению и повышению финансовой устойчивости (ПКН-3, УК-5). 1. Рассмотреть основные направления инвестиционной политики организации ее соответствие требованиям законодательства (ДКН-1/ПК-1); 2. Определить состав, структуру, динамику и доходность инвестиций организации, сделать выводы, объяснить	30

инвестиционной деятельности организации - базы производственной практики на финансовых рынках	причины выявленной динамики (ПКН-3); 3. Дать оценку эффективности инвестиционной деятельности организации обосновать предложения по ее совершенствованию с учетом текущей рыночной ситуации (ДКН-3/ПК-3, ДКН-4/ПК-4, ПКН-3).	
3. Договорные отношения и их совершенствование. Изучение и анализ договорной практики в организации	1. Разработка направлений совершенствования новых финансовых продуктов и услуг (ПКН-3, УК-5) 2. Оценка результатов внедрения инноваций финансовых рынках и роль структурных подразделений в полученных результатах (ДКН-1/ПК-1, ДКН-3/ПК-3, ДКН-4/ПК-4, УК-5)	10
4. Оформление результатов анализа и оценки деятельности финансовой организации	1.Обобщить результаты исследования в виде аналитического отчета (ПКН-3) 2. Определить на основе собранной информации перспективные направления деятельности организации с учетом формирующегося рыночного спроса (ДКН-1/ПК-1, ДКН-3/ПК-3, ДКН-4/ПК-4, ПКН-3); 3. Выработать командную стратегию для достижения поставленной цели (УК-5)	15
Итого		65

Таблица 3

Типы профессиональных задач	Виды работ (в форме контактной работы, в форме самостоятельной работы)	Количество часов (недель)
Научно-исследовательская	- исследование актуальных проблем развития современной финансово-кредитной сферы и финансов государственного сектора на основе поиска, сбора, обработки, анализа и систематизации информации в соответствии с разработанными планами и программами проведения исследований в области финансов и кредита;	50
	- разработка теоретических, динамических и экономико-математических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной деятельности, оценка и интерпретация полученных результатов, полученных на практике;	50
Аналитическая	- анализ и оценка эффективности применяемых методов и инструментов финансового и денежно-кредитного регулирования экономики в контексте обеспечения экономического роста и достижения финансовой стабильности;	40
	- анализ проектов бюджетов, финансовых прогнозов и планов финансово-хозяйственной деятельности,	40
	- анализ, оценка и совершенствование методики расчета финансово-экономических показателей, характеризующих деятельность организаций, органов государственной власти и местного самоуправления;	40

	- анализ и оценка деятельности как различных институтов и инфраструктуры финансового рынка, финансовых органов, так и состояния, тенденций, прогнозов развития мирового и российского финансового рынка, финансов государственного и негосударственного секторов экономики;	50
Проектно-экономическая	- подготовка финансового обоснования проектов и программ развития организаций, публично-правовых образований;	25
	- разработка проектов нормативных правовых документов, методических материалов, а также предложений и мероприятий по реализации подготовленных проектов и программ;	30
	- подготовка проектов бюджетов и финансовых планов на основе разработки и принятия инновационных решений финансово-экономических и управленческих задач как на уровне отдельных организаций, в том числе, институтов финансового рынка, так и на уровне публично-правовых образований;	30
	- владение новейшими методами и инструментами решения проектно-экономических задач, в том числе, в условиях цифровой экономики и развития Финтех;	25
	- разработка/участие в разработке ключевых показателей результативности деятельности/проекта (KPI) /использования финансовых ресурсов;	30
	- разработка принципов /основ формирования баз финансовой информации;	30
Организационно-управленческая	Участие в организационных мероприятиях организации – базы практики	4
	• разработка стратегии развития и финансовой политики как на уровне отдельных организаций, в том числе, институтов финансового рынка, так и на уровне публично-правовых образований;	36
	• управление денежными потоками на различных фазах экономического цикла, в том числе в условиях кризиса, владение методами антикризисного управления, оценки рисков и их хеджирования в целях достижения финансовой стабильности на макро-, мезо- и микроэкономическом уровнях и устойчивости организаций, финансовой и бюджетной систем;	50
	Подготовка отчета о практике	10
Итого:		540 часов

7. Формы отчетности по практике

Сроки производственной практики определяются приказом Финансового университета. В установленные сроки обучающийся должен представить в Департамент:

1. Рабочий график (план) проведения практики с подписями руководителей практики от Департамента финансовых рынков и финансового инжиниринга и организации по форме (Приложение 1)
2. Индивидуальное задание с подписями руководителей практики от Департамента финансовых рынков и финансового инжиниринга и организации по форме (Приложение 2)
3. Дневник практики обучающегося с подписью руководителя практики от организации и печатью организации по форме (Приложение 4)
4. Отзыв руководителя практики от организации с подписью и печатью организации (Приложение 5)
5. Отчет по практике с подписью и печатью организации и подписью руководителя от Департамента финансовых рынков и финансового инжиниринга и организации по форме (Титульный лист отчета - Приложение 3).

Обучающийся обязан явиться на защиту отчета о практике в Департамент финансовых рынков и финансового инжиниринга с полным комплектом документов.

По окончании производственной практики студент должен представить руководителю от Финансового университета Отчет о выполнении программы практики.

Отчет оформляется в бумажном виде, распечатывается на листах формата А4, без оборота. Основной текст в Отчете: шрифт times roman 14, межстрочный интервал 1,5, поля страниц 30*20*20*10 мм. Нумерация страниц Отчета производится внизу листа по центру, шрифт times roman 14. Отчет скрепляется в папке с мягкой обложкой, переплет «под дырокол», без использования прозрачных файлов для отдельных листов.

Формат титульного листа Отчета – Приложение 3. Титульный лист подписывается студентом, руководителем практики от организации (на титульном листе печать организации ставится), и предъявляется (вместе с корректно оформленным Отчетом) руководителю практики от Финансового

университета для защиты практики.

Структура Отчета по производственной практике:

1. Общая оценка финансово-экономического состояния объекта практики (направлений его деятельности в качестве регулятора финансового рынка)
2. Анализ практического материала по теме выпускной квалификационной работы (магистерской диссертации). Как правило, этот раздел должен коррелироваться с рядом пунктов второй главы диссертации и раскрывать пункты, изложенные в индивидуальном задании, полученном студентом.
3. Выводы и предложения.

Выводы (3-4) должны соответствовать индивидуальному заданию студента и по объему составлять не менее 0,5-1 страницы. Рекомендуется делать 1-2 вывода по каждому пункту индивидуального задания.

Отчет о выполнении программы производственной практики содержит основные описательные части выполнения индивидуального задания по практике. К Отчету студентом могут быть приложены материалы, отражающие результаты выполненной студентом работы в процессе прохождения практики: аналитические таблицы, справки, заключения, письма, акты и другие документы, в подготовке которых принимал участие студент.

Рекомендуемый объем Отчета по производственной практике, включая обязательные приложения – 20-25 страниц.

В Приложениях 4, 1 представлены форматы: Дневника практики, Рабочего графика (план) прохождения практики. Ежедневные записи студента в дневнике визируются (заверяются) руководителем практики от организации.

По результатам прохождения производственной практики руководителем практики от организации составляется Отзыв, в котором отражаются деловые качества студента, степень освоения им фактического материала, выполнение программы и графика прохождения производственной практики. В Отзыве отмечается, что по итогам практики обучающийся может (не может) быть допущен к защите отчета по практике. Отзыв заверяется подписью руководителя от базы практики и печатью организации. Требования к оформлению Отзыва –

Приложение 5.

Отзыв из организации о прохождении производственной практики студентом является фактическим подтверждением успешного прохождения практики студентом. Отсутствие корректно оформленного Отзыва, равно как и отсутствие корректно оформленного Отчета по практике, является основанием для не аттестации (незачета) по практике, и, как следствие, возникновения академической задолженности. Зачет с оценкой по практике, как правило, принимает руководитель практики от Финансового университета.

В рамках промежуточной аттестации могут создаваться комиссии с включением в их состав представителей организаций, на базе которых проводилась практика. Процедура промежуточной аттестации может проводиться непосредственно на базе организации, где проходила практика.

По итогам практики на основе оценки за выполненные студентом задания по практике и отзыва руководителей практики об уровне его знаний и квалификации осуществляется аттестация студента, позволяющая выставить ему зачет с оценкой. Студенты магистратуры, не выполнившие программу практики по уважительной причине, направляются на практику вторично, в свободное от учебы время. Студенты, не выполнившие программу практики без уважительной причины или получившие по её итогам неудовлетворительную оценку, имеют академическую задолженность. Оценки по всем видам практик приравниваются к оценкам по теоретическому обучению и учитываются при подведении итогов общей успеваемости студентов.

8. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по практике

Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения практики, содержится в разделе 3. «Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения при прохождении практики».

Таблица 3

Наименование компетенция	Индикаторы достижения компетенций	Типовые (примерные) задания для каждого индикатора достижения компетенций
компетенции направленности программы магистратуры ДКН для 2021г./ Профессиональные компетенции ПК для 2022г и т.д.		
ДКН-1/ПК-1 Способность осуществлять разработку теоретических и новых экономических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты, выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками	1. Использует весь спектр моделей и методов моделирования для отображения и выявления причинно-следственных связей во всем спектре экономических и финансовых объектов и рисков макро- и микроуровней.	Задание Сформулировать личную, обоснованную точку зрения на перспективы развития отдельных сегментов финансового рынка и места в них организации-базы практики в ближайшей перспективе на основе полученных в процессе обучения знаний и приобретенного в ходе производственной практики опыта.
	2. Демонстрирует возможности верификации результатов моделирования, содержательной и достоверной интерпретации причинно-следственных связей, прогнозирования изменений на макро- и микроуровнях.	Задание Оцените прогнозные значения параметров российского финансового рынка, указанные в «Стратегии развития российского финансового рынка до 2030 года» с позиции сегодняшних реалий.
	3. Использует системный анализ для поиска и структуризации решений по преодолению проблем и урегулированию рисков экономических и финансовых объектов.	Задание Перечислите индикаторы финансового рынка, являющиеся «индикаторами уязвимости финансового рынка». Объясните, почему.
ДКН-3/ПК-3 Способность применять теорию стохастических процессов для анализа и прогнозирования финансовых рынков	1. Владеет методами стохастики для изучения, интерпретации, объяснения и прогнозирования процессов макро- и микроуровней на финансовых рынках.	Задание Описать существующие концепции, модели развития организации (структуру стратегии, цели, задачи, период и его обоснование)
	2. Широко использует программный инструментарий, базы данных и современные методы их обработки для	Задание Опишите какие социально-экономические проблемы решает Стратегия.

	построения и интерпретации моделей стохастических процессов на финансовых рынках.	Сравните тенденции развития стратегии организации с отраслевой стратегией. Выявите общее и различия
ДКН – 4/ПК-4 Способность управлять инвестиционным портфелем индивидуальных и институциональных инвесторов на основе фундаментального и технического анализа, оценки финансовых инструментов, оценки финансовых рисков и управления рисками инвестиционного портфеля	1.Использует методический инструментарий оценки эффективности управления портфелем финансовых активов, деятельности профессиональных участников финансового рынка.	Задание Портфель инвестора составлен из акций А и В. Удельные веса акций А и В в портфеле составляют соответственно 40% и 60%. Дисперсия доходности акции А равна 625, дисперсия доходности акции В равна 729, ковариация доходностей А и В равна 246. Какова дисперсия доходности портфеля? Ответы: А. 118,08; В.131,8; С. 480,52; D. 318,08
	2.Использует методы оценки финансовых рисков для выработки рекомендаций по их эффективному хеджированию.	Задание Определить риск портфеля, состоящего из акций компаний А и В, если удельный вес актива А в портфеле –0,4, удельный вес актива В в портфеле – 0,6. Стандартное отклонение доходности акции А –20%, стандартное отклонение доходности акции В –30%, ковариация доходностей активов А и В –120. Ответы: А. 266; В. 445,6; С. 628
ПКН - 3 Способность проводить анализ, обобщать и критически оценивать полученные результаты исследования для разработки финансовых аспектов перспективных направлений инновационного развития, минимизации рисков, достижения финансовой устойчивости организаций (включая финансово-	1.Владеет методами прикладных научных исследований в профессиональной сфере.	Задание Применяя методы научных исследований (определение средних величин, экстраполяции и т.п.) выявить тенденции развития российских финансовых рынков в кратко- и среднесрочной перспективе
	2.Применяет современные методы анализа и оценки рисков деятельности организаций	Задание Проанализировать факторы финансовой устойчивости

кредитные организации), долгосрочной устойчивости бюджетной системы, составления финансовых обзоров, экспертно-аналитических заключений, отчетов и научных публикаций в области финансов и кредита	(включая финансово-кредитные организации), бюджетных рисков и предлагает решения по их минимизации в контексте достижения финансовой стабильности и долгосрочной устойчивости.	финансовой организации – базы производственной практики. На основе анализа сделать вывод об уровне ее стабильности и финансовой устойчивости.
	3.Разрабатывает направления инновационного развития как организаций (включая финансово-кредитные организации), отдельных продуктов и услуг, так и публично-правовых образований.	Задание Определить на основе специализированных источников инновационные продукты, предлагаемые рынком, и определить перспективы потребительского спроса на них в организации – базе производственной практики
	4.Оформляет результаты анализа и оценки в форме финансовых обзоров, экспертно-аналитических заключений	Задание Проанализировать результаты оценки финансовой устойчивости финансовой организации – базы производственной практики, сформулировать экспертное заключение о наличии проблемных аспектов в части финансовой устойчивости организации, предложить направления совершенствования деятельности организации.
УК - 5 Способность руководить работой команды, принимать организационно-управленческие решения для достижения поставленной цели, нести за них ответственность	1. Демонстрирует понимание последовательности этапов решения поставленных практических задач	Задание. Опишите источники информации, требуемые для проведения анализа финансово-хозяйственной деятельности
	2. Оценивает на основании анализа деятельности организации и ее отдельных подразделений результаты их деятельности	Задание На основе проведенного анализа, выявить периоды или структурные подразделения, имевшие наилучшие результаты деятельности
	3. Разрабатывает предложения по улучшению показателей финансово-хозяйственной деятельности на основе применения методов построения конструктивного диалога с	Задание Обосновать основные мероприятия, направленные на улучшение показателей финансово-хозяйственной

	сотрудниками	деятельности
--	--------------	--------------

«Оценка уровня сформированности компетенций осуществляется на основании материалов, собранных в процессе прохождения практики, качества выполнения и оформления отчета о прохождении практики, содержания доклада на его защите и ответов на вопросы».

9. Перечень учебной литературы и ресурсов сети «Интернет», необходимых для проведения практики:

Законодательные и нормативные акты

1. Гражданский кодекс Российской Федерации. Часть первая, вторая.
2. Федеральный Закон «О рынке ценных бумаг» от 22.04. 1996 г., №39-ФЗ
3. Федеральный Закон «Об инвестиционных фондах» от 21.11. 2001г., №156-ФЗ
4. Федеральный закон «Об организованных торгах». от 21 ноября 2011 г. № 325 ФЗ
5. Стратегия развития финансового рынка Российской Федерации на период до 2020 года. Утверждена распоряжением Правительства РФ от 29 декабря 2008 г. № 2043-р

Основная литература

6. Шарп, У. Ф. Инвестиции : учебник / У. Ф. Шарп, Г. Д. Александер, Д. В. Бэйли ; пер. с англ. А. Н. Буренина, А. А. Васина. – Москва : ИНФРА-М, 2022. – XII,1028 с. – (Университетский учебник). – ISBN 978-5-16-016789-3. – ЭБС Znanium.com. – URL: <https://znanium.com/catalog/product/1817592> (дата обращения: 29.01.2023). – Текст : электронный.
7. Криничанский, К. В. Рынок ценных бумаг : учеб. для магистратуры / К. В. Криничанский ; Финуниверситет. – Москва : Прометей, 2021. – 412 с. – ISBN 978-5-00172-156-7. – Текст : непосредственный.

8. Финансовые рынки : учебник / А. П. Чигринская, М. В. Чернышова, Б. В. Сребник [и др.] ; под ред. С. В. Брюховецкой, Б. Б. Рубцова ; Финуниверситет. – Москва : КноРус, 2021. – 462 с. – ISBN 978-5-406-04050-8. – ЭБС BOOK.RU. – URL: <https://book.ru/book/936687> (дата обращения: 29.01.2023). – Текст : электронный.

Дополнительная литература

9. Международный финансовый рынок : учебник / Е. А. Звонова, В. К. Бурлачков, В. А. Галанов [и др.] ; под ред. В. А. Слепова ; Российский экон. ун-т им. Г. В. Плеханова. –2-е изд., перераб. и доп. – Москва : Магистр : ИНФРА-М, 2018. – 368 с. – ISBN 978-5-9776-0302-7. – ЭБС Znanium.com. – URL: <https://znanium.com/catalog/product/945333> (дата обращения: 29.01.2023). – Текст : электронный.

10. Миркин, Я. М. Финансовое будущее России: экстремумы, бумы, системные риски. – Москва : GELEOS PublishingHouse : Кэпитал Трейд Компани, 2011. – 480 с. – Портал «Финансовые науки» Миркин.ру : [сайт]. – URL: <http://www.mirkin.ru/fin-future/> (дата обращения: 29.01.2023). – Текст : электронный.

11. Мэрфи, Дж. Технический анализ фьючерсных рынков: Теория и практика : пер. с англ. / Джон Дж. Мэрфи. – Москва : Альпина Пабlishер, 2016. – 610 с. – (Инвестиции и трейдинг). – ЭБС ALPINADIGITAL. – URL: <https://finunivers.alpinadigital.ru/book/432> (дата обращения: 29.01.2023). – Текст : электронный.

12. Оценка стоимости бизнеса : учебник / М. А. Эскиндаров, М. А. Федотова, Н. А. Атабиева [и др.] ; под ред. М. А. Эскиндарова, М. А. Федотовой. — 2-е изд., стер. — Москва : КноРус, 2023. — 320 с. — ISBN 978-5-406-10616-7. — URL: <https://book.ru/book/945959> (дата обращения: 29.01.2023). — Текст : электронный.

13. Проблемы развития доверительного управления в Российской Федерации : монография / Б. Б. Рубцов, К. Р. Адамова, Л. Н. Андрианова [и др.] ; под ред. Б. Б.

Рубцова ; Финуниверситет. – Москва : Русайнс, 2015. – 168 с. – ISBN 978-5-4365-0229-8. – Текст : непосредственный.

14. Финансовые рынки: цифровая трансформация : монография / К. В. Криничанский, А. С. Генкин, Е. Н. Клочкова [и др.] ; под ред. К. В. Криничанского, Б. Б. Рубцова ; Финуниверситет. – Москва : РУСАЙНС, 2021. – 184 с. – ISBN 978-5-4365-6754-9. – ЭБС BOOK.ru. – URL:<https://book.ru/book/940239> (дата обращения: 29.01.2023). – Текст : электронный.

Интернет-ресурсы

1. www.raexpert.ru - Экспертное агентство «ЭкспертРА»
2. www.mirkin.ru – портал «Финансовые науки»
3. Сайт Московской биржи www.moex.ru
4. Аналитический портал Финам www.finam.ru
5. Официальный сайт Центра макроэкономического анализа и краткосрочного планирования www.forecast.ru.
6. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики www.gks.ru.
7. Интернет-ресурс газеты Ведомости www.vedomosti.ru.
8. Интернет-ресурс анализа финансовых рынков www.confindex.ru
9. Информационное агентство Refinitiv (ThomsonReuters) <http://ru.reuters.com/>
10. Электронно-библиотечная система Znanium <http://www.znanium.com>
11. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ» <https://urait.ru/>
12. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>

10. Перечень информационных технологий, используемых при проведении практики, включая перечень необходимого программного обеспечения и

информационных справочных систем

10. 1. Комплект лицензионного программного обеспечения:

1. Windows, Microsoft Office.
2. Антивирус Kaspersky

10.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Информационно-правовая система «Гарант»
2. Информационно-правовая система «Консультант Плюс»
3. «Bloomberg», СПАРК-Интерфакс
4. Электронная энциклопедия: <http://ru.wikipedia.org/wiki/Wiki>
5. Система комплексного раскрытия информации «СКРИН» - <http://www.skrin.ru/>

Электронные библиотеки

1. Электронная библиотека Финансового университета (ЭБ) <http://elib.fa.ru/>
2. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>
3. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ОНЛАЙН» <http://biblioclub.ru/>
4. Электронно-библиотечная система Znaniium <http://www.znaniium.com>
5. «Деловая онлайн библиотека» издательства «Альпина Паблишер» <http://lib.alpinadigital.ru/en/library>
6. Электронно-библиотечная система издательства «Лань» <https://e.lanbook.com/>
7. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ» <https://www.biblio-online.ru/>
8. Научная электронная библиотека eLibrary.ru <http://elibrary.ru>
9. Электронная библиотека диссертаций Российской государственной библиотеки (ЭБД РГБ) <https://dvs.rsl.ru>

10.3. Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации

Не требуются

11. Описание материально-технической базы, необходимой для проведения практики

Учебно-лабораторное оборудование: персональный компьютер, проектор и иное мультимедийное оборудование учебных аудиторий

Программные, технические и электронные средства обучения и контроля знаний студентов обучающихся, размещенные на портале Финансового университета и доступные для использования в точках удаленного доступа и/или в помещениях Университета (электронная библиотека, программы для компьютерного тестирования, видео-лекции, учебно-методические материалы и др.)

**Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»
(Финансовый университет)**

Факультет _____

Департамент/Кафедра _____

РАБОЧИЙ ГРАФИК (ПЛАН)

проведения _____ практики _____
(указать вид (тип/типы) практики)

обучающегося _____ курса _____ учебной группы

(фамилия, имя, отчество)

Направление подготовки/Специальность _____

(наименование направления подготовки/специальности)

(профиль образовательной программы бакалавриата/направленность образовательной программы магистратуры/направленность образовательной программы специалитета)

Место прохождения практики _____

Срок практики с _____ 20__ г. по _____ 20__ г.

№ п/п	Этапы практики по выполнению программы практики и индивидуального задания	Продолжительность каждого этапа практики (количество дней)
1	2	3
Организационно-подготовительный этап:		
Основной этап:		
Заключительный этап:		

Руководитель практики от департамента/кафедры: _____
(подпись) (И.О. Фамилия)

Руководитель практики от организации: _____
(подпись) (И.О. Фамилия)

Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»
(Финансовый университет)

Факультет _____

Департамент/кафедра _____

ИНДИВИДУАЛЬНОЕ ЗАДАНИЕ

по _____ практике
(указать вид (тип/типы) практики)

обучающегося _____ курса _____ учебной группы

(фамилия, имя, отчество)

Направление подготовки _____
(наименование направления подготовки)

(профиль образовательной программы бакалавриата/направленность образовательной программы магистратуры)

Место прохождения практики _____

Срок практики с «__» _____ 20__ г. по «__» _____ 20__ г.

№ п/п	Содержание индивидуального задания и планируемые результаты
1	2
	Содержание индивидуального задания
	Планируемые результаты практики

Руководитель практики от департамента/кафедры: _____
(подпись) (И.О. Фамилия)

Задание принял обучающийся: _____
(подпись) (И.О. Фамилия)

СОГЛАСОВАНО

Руководитель практики от организации: _____
(подпись) (И.О. Фамилия)

Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»
(Финансовый университет)

Факультет _____

Департамент/кафедра _____

ОТЧЕТ

по _____ практике
(указать вид (тип/типы) практики)

Направление подготовки _____
(наименование направления подготовки)

(профиль образовательной программы бакалавриата/направленность образовательной программы магистратуры)

Выполнил:

обучающийся учебной группы _____

(подпись)

(И.О. Фамилия)

Проверили:

Руководитель практики от организации:

(должность)

(И.О. Фамилия)

(подпись)

М.П.

Руководитель практики от
департамента/кафедры:

(ученая степень и/или звание)

(И.О. Фамилия)

(оценка)

(подпись)

Москва – 20 __

Содержание

(отчета по практике)

1. Общая характеристика деятельности организации
2. Содержание и состав выполняемых организацией операций и оказываемых услуг
3. Описание деятельности подразделения, в котором проходила практика
4. Выводы и предложения
5. Приложения, в том числе: индивидуальное задание, рабочий график (план), дневник практики, учет выполненной работы

К отчету прикладывается оформленный Отзыв из организации о прохождении практики студентом

Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»
(Финансовый университет)

Факультет _____

Департамент/кафедра _____

ДНЕВНИК

по _____ практике
(указать вид (тип/типы) практики)

обучающегося _____ курса _____ учебной группы

(фамилия, имя, отчество)

Направление подготовки _____
(наименование направления подготовки)

(профиль образовательной программы бакалавриата/направленность образовательной программы магистратуры)

Москва – 20 ____

Место прохождения практики _____

Срок практики с «__» _____ 20__ г. по «__» _____ 20__ г.

Должность, ФИО руководителя практики от организации _____

УЧЕТ ВЫПОЛНЕННОЙ РАБОТЫ

Дата	Департамент/ Управление/ отдел	Краткое содержание работы обучающегося	Отметка о выполнении работы (подпись руководителя практики)
1	2	3	4

Руководитель практики от организации: _____

(подпись) (И.О.Фамилия)

М.П.

ФИРМЕННЫЙ БЛАНК ОРГАНИЗАЦИИ (БАНКА)

ОТЗЫВ

о прохождении практики

Обучающийся _____
(Ф.И.О.)

Факультет _____

проходил(а) _____ практику
(вид практики)

в период с « _____ » _____ по « _____ » _____ 20__ г.

в _____

(наименование организации, наименование структурного подразделения)

В период прохождения практики _____
(Ф.И.О. обучающегося)

поручалось решение следующих задач:

В период прохождения практики обучающийся проявил(а)

Результаты работы обучающегося:

Считаю, что по итогам практики обучающийся может (не может) быть допущен к защите отчета по практике.

(должность руководителя практики от организации) _____ (подпись) _____ (Ф.И.О.)

« _____ » _____ 20__ г.

М.П.

Отзыв подписывается руководителем практики от организации и заверяется печатью организации.